

2 июня 2003

КЛЮЧЕВЫЕ НОВОСТИ

Сегодня:

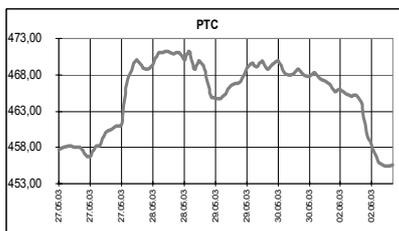
- ✓ Пройдет годовое собрание акционеров ОАО "Роснефть-Туапсенефтепродукт".
- ✓ Пройдет годовое собрание акционеров ОАО "Уралкалий".

Вчера:

- ✓ За вчерашний день индекс РТС снизился на 2,45% до 455,66 пункта (объем торгов составил \$22,46 млн.). Акции РАО ЕЭС (-4,0) вновь оказались лидером падения. Не очень позитивные финансовые результаты ЛУКОЙла (1,8%) также отразились на цене его бумаг на рынке. Газпром на СПФБ вырос до 30,96 руб. при объеме 10,60 млн. штук.
- ✓ Индекс российских менеджеров по снабжению, характеризующий состояние производственного сектора в России, вырос в мае года до 53,7 с 51,8 в апреле.
- ✓ Чистая прибыль ЛУКОЙла по US GAAP по предварительным данным снизилась в 2002 году до \$1,843 млрд. с \$1,952 млрд. в 2001 году.
- ✓ Рейтинговое агентство S&P присвоило банку Русский Стандарт долгосрочный кредитный рейтинг В-.
- ✓ Убыток Мосэнерго по МСФО за 2002 год составил 2,3 млрд. рублей, при этом выручка компании выросла на 20,6% - до 56,3 млрд. рублей.

Сегодня мы выпускаем сокращенный вариант ежедневного обзора в связи с командировкой нашего аналитика Дмитрия Гвоздецкого.

| Бумага | Закрытие | | Изм. ADR | Объем |
|----------------|----------|----------|----------|-------|
| | РТС | ADR | | |
| Газпром (Фр.) | \$1,0098 | \$1,7550 | -1,06% | 728,4 |
| РАО ЕЭС | \$0,2185 | \$0,2150 | -4,87% | 5,5 |
| Мосэнерго | \$0,0670 | \$0,0675 | 0,00% | 20,2 |
| ЛУКОЙл | \$17,970 | \$17,913 | -3,18% | 210,7 |
| Сургутнефтегаз | \$0,4075 | \$0,4010 | -4,43% | 19,5 |
| Татнефть | \$1,0750 | \$1,0800 | 1,17% | 64,1 |
| ЮКОС | \$12,200 | \$12,123 | -3,02% | 221,5 |
| Норникель | \$27,800 | \$27,760 | -1,74% | 243,9 |
| Ростелеком | \$1,7910 | \$1,7750 | -3,01% | 37,6 |
| Вымпелком | | \$45,150 | 0,33% | 119,2 |
| МТС | | \$53,250 | -1,02% | 213,7 |
| ВБД | | \$21,400 | 1,95% | 237,7 |



| | 30.05.03 | 02.06.03 | Измен. |
|---------|----------|----------|--------|
| RUR/\$ | 30,7090 | 30,6400 | -0,22% |
| \$/Euro | 1,1784 | 1,1768 | -0,14% |
| Yen/\$ | 119,31 | 118,61 | -0,59% |

| Индексы | 02.06.03 | Изм. за день, % | Изм. за день | Мин., за нед. | Макс., за нед. | Изм. с нач. года, % |
|-----------|----------|-----------------|--------------|---------------|----------------|---------------------|
| PTC | 455,66 | -2,45 | -11,44 | 455,52 | 471,22 | 26,90 |
| UPI | 415,43 | -0,51 | -2,11 | 415,43 | 424,55 | 27,69 |
| UPMI | 302,14 | -3,11 | -9,70 | 302,14 | 311,84 | 27,95 |
| DJIA | 8897,81 | 0,54 | 47,55 | 8523,64 | 9040,46 | 6,67 |
| NASDAQ | 1590,75 | -0,32 | -5,16 | 1504,22 | 1620,79 | 19,11 |
| S&P500 | 967,00 | 0,35 | 3,41 | 927,33 | 979,11 | 9,91 |
| Merval | 702,76 | N/a | N/a | 651,28 | 687,43 | 33,87 |
| Bovespa | 13228,78 | N/a | N/a | 12852,46 | 13507,26 | 17,40 |
| Nikkei | 8564,49 | N/a | N/a | 8106,90 | 8461,73 | -0,17 |
| Kospi | N/a | N/a | N/a | N/a | N/a | N/a |
| Hang Seng | 9675,97 | N/a | N/a | 9411,32 | 9587,17 | 3,81 |
| FTSE | 4129,30 | 2,01 | 81,20 | 3920,20 | 4095,50 | 4,79 |
| DAX | 3064,56 | 2,75 | 81,88 | 2769,45 | 2968,43 | 5,94 |
| CAC | 3048,32 | 1,89 | 56,57 | 2826,81 | 2985,85 | -0,51 |

| Товарные рынки | 02.06.03 | Изм. | Изм., % | Мин., за нед. | Макс., за нед. | Изм. с нач. года, % |
|-----------------------------|----------|--------|---------|---------------|----------------|---------------------|
| Brent, спот | N/a | N/a | N/a | N/a | N/a | N/a |
| Brent, июль. фьючерс, IPE | 27,38 | 0,43 | 1,60 | 25,60 | 27,38 | -7,47 |
| Brent, август. фьючерс, IPE | 26,88 | 0,83 | 3,19 | 25,43 | 26,88 | -9,16 |
| Urals, спот | N/a | N/a | N/a | N/a | N/a | N/a |
| Никель, LME | 9270,00 | 340,00 | 3,81 | 8555,00 | 9270,00 | 30,75 |
| Медь, LME | 1704,50 | 22,50 | 1,34 | 1680,00 | 1704,50 | 11,01 |
| Цинк, LME | 782,50 | 13,50 | 1,76 | 769,00 | 785,50 | 4,47 |
| Золото, спот | N/a | N/a | N/a | N/a | N/a | N/a |

Экономические индикаторы США:

| Дата | Параметр | Период | Значение | Ожидания рынка | Предыдущее значение |
|---------|-----------------------------------|--------------|----------|----------------|---------------------|
| Июнь 02 | ISM index | Май | 49,4 | 48,5 | 45,4 |
| Июнь 02 | Расходы на строительство | Апрель | -0,3% | 0,2% | -1,0% |
| Июнь 03 | Продажи легковых автомобилей | Май | - | 5,4 млн | 5,4 млн |
| Июнь 03 | Продажи грузовых автомобилей | Май | - | 7,5 млн | 7,6 млн |
| Июнь 04 | Производительность | Q1 I квартал | - | 2,0% | 1,6% |
| Июнь 04 | ISM services | Май | - | 52,0 | 50,7 |
| Июнь 05 | Первичная безработица | 05/31 | - | 421 тыс | 424 тыс |
| Июнь 05 | Промышленные заказы | Апрель | - | -1,8% | 2,2% |
| Июнь 06 | Количество созданных рабочих мест | Май | - | -30 тыс | -48 тыс |
| Июнь 06 | Уровень безработицы | Май | - | 6,1% | 6,0% |
| Июнь 06 | Почасовая заработная плата | Май | - | 0,2% | 0,1% |
| Июнь 06 | Продолжительность рабочей недели | Май | - | 34,2 | 34,0 |
| Июнь 06 | Потребительский кредит | Апрель | - | \$2,2 млрд | \$0,9 млрд |

Комментарий к рыночной ситуации

Вчерашний день был показательным в смысле демонстрации того факта, что не так уж много на рынке осталось идей, способных вознести его на новые максимумы. Годовые собрания акционеров в главных энергокомпаниях прошли, расстановка сил и контуры новой, более "глобализированной" нефтяной отрасли в целом ясны, компании связи также значительно продвинулись к своим справедливым оценкам. В такой ситуации даже небольшого негативного сигнала (такого, как слабый финансовый отчет ЛУКОЙла) оказалось достаточно, чтобы довольно сильно уронить рынок. Мы ждем, что сегодня снижение цен российских акций продолжится, причем, как и вчера, наиболее сильно пострадают бумаги "дорогой" нефтянки.

СОЕДИНЕННЫЕ ШТАТЫ

Dow Jones Industrial Average :
8,897.81 ↑ 47.55 0.54%



NASDAQ :
1,590.75 ↓ -5.16 -0.32%



S & P 500:
967.00 ↑ 3.41 0.35%



Рынок

По итогам торгов: индекс Dow Jones прибавил 0,54% до 8897,81 пункта, Nasdaq снизился на 0,32% до 1590,75 пункта, S&P 500 увеличился на 0,35% до 967 пункта. Объем торгов на Nasdaq значительно вырос 2,506 млрд. акций, на NYSE 1,451 млрд. акций.

Акции биотехнологического сектора были лидерами роста после публикации несколькими компаниями положительных результатов испытаний препаратов против лечения рака и онкологический заболеваний.

Институт менеджеров по поставкам ISM сообщил, что в мае состояние сектора производства улучшилось. Индекс ISM вырос с 45,4 пункта в апреле до 49,4 пункта. Тем не менее, значение индекса ISM продолжает оставаться ниже уровня в 50 пунктов, что свидетельствует о сокращении в сфере производства.

Фьючерсы на американские индексы в пятницу утром торгуются в плюсе: фьючерсы на Nasdaq +0,3%, фьючерсы на S&P 500 +0,27%.

Итоги торгов на ММВБ, СПФБ. Технический комментарий.

| Эмитент | Объем сделок, шт. | Цены | | | Измен. цены, % | | | | Подд.1 | Подд.2 | Сопр.1 | Сопр.2 |
|-----------------------|-------------------|----------|----------|----------|----------------|---------|---------|-------------|--------|--------|--------|--------|
| | | Посл. | Мин. | Макс. | за день | за нед. | за мес. | с нач. года | | | | |
| Газпром, СПФБ | 10601100 | 30,960 | 30,500 | 31,350 | 1,31 | -3,94 | 6,50 | 27,83 | 30 | 27 | 35 | |
| ГМК Норильский никель | 356021 | 848,000 | 834,220 | 862,000 | -0,59 | 4,31 | 18,60 | 31,47 | 750 | 710 | 800 | 850 |
| Лукойл | 1447233 | 550,000 | 545,200 | 571,950 | -1,79 | 0,73 | 2,59 | 12,18 | 540 | 509 | 586 | |
| Мосэнерго-3 | 60109700 | 2,100 | 2,031 | 2,122 | -0,52 | -1,27 | -2,33 | 109,79 | 2,00 | 1,64 | 2,30 | |
| РАО ЕЭС России | 592605400 | 6,670 | 6,627 | 7,019 | -4,03 | -5,66 | 42,37 | 62,09 | 6,50 | 6,00 | 7,70 | 8,60 |
| РАО ЕЭС России прив. | 2336400 | 5,351 | 5,246 | 5,457 | -1,80 | -4,02 | 33,98 | 58,92 | 5,20 | 4,50 | 6,18 | |
| Ростелеком | 8061655 | 54,160 | 54,020 | 56,900 | -2,04 | -6,60 | 23,51 | 41,41 | 52,5 | 49 | 60 | 75 |
| Сбербанк | 13011 | 7962,990 | 7929,000 | 8249,000 | -1,33 | -5,26 | 12,92 | 30,33 | 8000 | 7250 | 8500 | |
| Сибнефть | 229500 | 74,000 | 73,810 | 76,530 | -2,37 | 0,28 | 1,25 | 4,92 | 74 | 70 | 80 | |
| Сургутнефтегаз | 15288700 | 12,630 | 10,300 | 12,860 | -0,79 | -2,09 | 2,52 | 24,54 | 12,10 | 11,05 | 13,50 | 15,00 |
| Сургутнефтегаз прив. | 1877800 | 7,640 | 7,620 | 7,840 | -1,43 | 2,66 | 6,11 | -2,68 | 7,00 | 6,60 | 8,20 | 9,30 |
| Татнефть-3 | 1075800 | 33,100 | 32,460 | 33,900 | 0,24 | -5,27 | 22,46 | 32,51 | 30,3 | 26 | 35 | |
| ЮКОС-2 | 941965 | 373,000 | 371,500 | 387,500 | -1,84 | -0,96 | 3,04 | 25,38 | 353 | 283 | 410 | |

Итоги торгов корпоративными облигациями на ММВБ

| Тикер | Последняя | Изменение | Оборот | Доходн. | НКД |
|---------|-----------|-----------|--------|---------|-------|
| AFNB01 | 100,15 | -0,15% | 20083 | 11,98 | 84,33 |
| ALEC01 | 107,8 | -0,22% | 5180 | 14,95 | 23,03 |
| ALRB19 | 113,55 | -0,87% | 43150 | 9,75 | 17,1 |
| BNRG01 | 118,01 | -0,63% | 3500 | 11,13 | 44,38 |
| СТКМ01 | 104 | -0,46% | 1 | 9,16 | 6,41 |
| GAZB02 | 114 | -0,51% | 42955 | 8,87 | 6,25 |
| IAPO01 | 100,8 | -0,23% | 5000 | 11,81 | 21,04 |
| IZHM01 | 100,6 | 0,10% | 1 | 18,36 | 27,78 |
| KLNA02 | 102 | 0,20% | 86 | 12,26 | 8,1 |
| KOMI05 | 114 | -0,74% | 560 | 11,67 | 34,52 |
| LMKB01 | 105,4 | -0,14% | 50 | 13,09 | 13,11 |
| MGOR23 | 104,9 | 0,19% | 2000 | 5,93 | 31,23 |
| MGOR25 | 106,69 | -0,01% | 54 | 6,7 | 27,54 |
| MGOR27 | 122,7 | -0,46% | 8990 | 7,87 | 30,41 |
| MKHB01 | 79 | 1,28% | 377 | 60,95 | 27,4 |
| NKNH02 | 115,2 | -0,13% | 4000 | 9,17 | 4,68 |
| NKSL02 | 103,05 | -0,09% | 741 | 8,86 | 27,9 |
| NMAZ01 | 109,5 | 9,01% | 2400 | 11,57 | 92,96 |
| PKBO01 | 109,6 | 0,50% | 4625 | 20,19 | 38,14 |
| RSTF01 | 111,75 | -0,13% | 6455 | 14,28 | 58,89 |
| SMRT01 | 111 | | 160 | 13,91 | 6,03 |
| SUEK01 | 106,2 | -0,05% | 1 | 14,41 | 18,63 |
| TATB01 | 109,1 | -0,14% | 110 | 16,03 | 0,45 |
| TATB02 | 103,91 | -0,09% | 30 | 16,04 | 4,62 |
| TNK0401 | 106,9 | -0,12% | 2000 | 4,64 | 21,7 |
| TNK0501 | 116,9 | -0,76% | 39970 | 9,44 | 1,23 |
| USIB02 | 114,5 | -0,87% | 6750 | 10,4 | 6,71 |

Лучшие/худшие акции, изм. за день, %

